（上接B42版）

[1]本基金管理人对股票型基金的定义为：主要投资于股票的基金，其股票投资占资产净值的比例大于等于60%；对债券型基金的定义为：主要投资于债券的基金，其债券投资占资产净值的比例大于等于80%；对配置型基金的定义为：投资于股票、债券以及货币市场工具的基金，且不符合股票型基金和债券型基金的分类标准；对货币市场基金的定义为：主要投资于货币市场工具的基金，货币市场工具包括短期债券、央行票据、回购、同业存款、大额存单、商业票据等；对保本基金的定义为：基金招募说明书中明确规定相关的担保条款，即在满足一定的持有期限后，为投资人提供本金或收益的保障。

本基金将除指数型基金外的所有其他封闭式基金全部归为偏股型基金。

●基金的定量评级

本基金认为，对基金评级的主要依据为其投资业绩，但对基金历史业绩的考察应该是一个长期的过程。由于目前国内基金（特别是开放式基金）的运作历史相对较短，满足长期业绩评级标准的基金数量十分有限，因此本基金选择以一年作为基金评级的考察区间。未来，随着国内基金运作时间的增加，本基金将会选择新的考察区间，具体变化另行公告。

本基金主要选用两个定量指标作为基金评级指标。

核心指标：詹森指数（Jensen Index），用以评价基金业绩（包括选股能力）；

辅助指标：业绩持续性回归指标，用以评价基金业绩的持续性。

本基金采用评分制（Scoring Method）对所有偏股型基金进行评级。评级程序如下：

★ 分别计算所有偏股型基金的基金业绩评估值（核心指标）及基金业绩持续性评估值（辅助指标），并按照计算值进行由高到低的排名；

★ 分别对上述两序列中的基金排名进行加权计算，其中：核心指标权重高（如70%），辅助指标权重低（如30%）；

★ 二者相加后得到的总分值即为确定基金评级的最终得分。

本基金将得分最低的前10%基金评为5星级基金，其次22.5%评为4星；中间35%评为3星；随后22.5%评为2星；末尾10%评为1星。

●备选基金的二次筛选与绩优基金池的构建

本基金将所有3、4、5星级基金列为备选基金。在这些基金中，本基金管理人还将通过对基金经理评价以及对基金管理公司评价等一系列以定性分析为主的指标做进一步筛选，再次剔除部分基本面情况存在重大问题的基金，最终形成用以确定绩优基金重仓股的基金池。

●优选基金的评估期限

本基金管理人每半年将根据公开信息对偏股型基金进行一次整体评估，从而筛选出绩优基金，用以构建确定绩优基金重仓股的基金池。

【2】优选绩优基金重仓股，构建绩优基金重仓股优选指数（虚拟指数）

绩优基金重仓股优选指数为本基金管理人自行编制的虚拟指数，在实行“核心—卫星”总体策略过程中，该虚拟指数是核心组合部分进行指数化跟踪策略的基础。本基金认为，基金行业的整体表现已经逐渐赢得了广大投资者的认同。基金重仓股作为各基金的核心配置品种，对基金业绩贡献率最为突出。并且，基于基金行业层面的统计分析表明，基金重仓股季度间的变化相对较小，买入持有特征较为显著，因此选择绩优基金重仓股并实施有效的跟踪策略是本基金核心组合部分采用的中长期策略。

●绩优基金重仓股优选指数（虚拟指数）的构建程序

★ 根据基金行业定期披露的季报内容，本基金管理人将对各绩优基金的十大重仓股进行汇总，并定义这些股票为绩优基金重仓股；

★ 所有绩优基金持有单只股票的持仓市值之和定义为该绩优基金重仓股持仓市值；

★ 重点关注高持仓市值的绩优基金重仓股，并综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制、重大调仓信号、行业研究员分析评估等因素，挑选并构成绩优基金重仓股优选指数的成分股；

★ 成分股的持仓市值总和不低于绩优基金重仓股持仓市值总和的80%，即覆盖率达到80%以上；

★ 以各成分股持仓市值作为各成分股对应的核心参考权重。

●绩优基金重仓股优选指数（虚拟指数）的调整期限

本基金管理人基于基金行业定期披露的基金季报内容，对核心组合部分进行及时调整，纳入将进入绩优基金重仓股优选指数的股票，剔除将调出绩优基金重仓股优选指数的股票，并在基金行业公布季报内容后的1个月内，以调整后的绩优基金重仓股优选指数成分股权重为基础，重新构建核心部分投资组合。

【3】绩优基金重仓股优选指数（虚拟指数）的跟踪策略

●绩优基金重仓股优选指数（虚拟指数）的适度调整

本基金管理人将在重点参考各成分股与对应的核心参考权重进行核心部分资产配置的前提上，采用适度调整策略，即：对成分股进行适度调整；对成分股权重进行适度调整。

本基金管理人将基于股票超额收益率定量预测结果，结合行业研究员对成分股公司基本面的定性分析，决定是否对成分股进行适度调整。

如果进行调整，本基金管理人将绩优基金重仓股优选指数的成分股分为三类：正超额收益预期的成分股；负超额收益预期的成分股；无超额收益预期的成分股。根据交易成本与预期超额收益率的估算，适度增加正超额收益预期成分股的权重，适度降低负超额收益预期成分股的权重，保持无超额收益预期的成分股票核心权重不变。

●绩优基金重仓股优选指数（虚拟指数）投资跟踪误差的控制

通常情况下，本基金管理人将力争保持绩优基金重仓股优选指数的客观性、透明性与稳定性。但当本基金管理人在认定绩优基金重仓股优选指数成分股发生基本面恶化、投资价值降低等特殊情形时，将有权进行突发性调整。

由于交易成本、交易冲击、流动性、核心参考权重的适度调整、成分股的调入／调出、申购／赎回资金、投资比例限制等因素都可能导致核心组合部分的被动介位发生变动，从而使投资组合对绩优基金重仓股优选指数产生偏离，因此，本基金将采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对核心组合部分的投资进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制核心组合部分相对于基金重仓股优选指数的偏离风险。

核心监控指标：

$$\sum_{t=1}^{n}(r_t-\bar{r})^2 \qquad \cdots$$

$$\cdots \qquad \cdots$$

$$\cdots \qquad \cdots$$

辅助监控指标：

跟踪偏离度＝前n日前基金累计收益率－前n日度拟指数累计收益率。

上述跟踪误差指标的最大容忍值设定为0.5%（相应折算的年跟踪误差约为7.75%）。本基金每周计算上述跟踪误差。如果该指标接近或者超过0.5%，并且跟踪偏离度小于0，则本基金管理人将通过归因分析模型找出跟踪误差的来源，并在适当的时机进行再平衡调整操作，使得跟踪误差回复到最大容忍值以下。

当本基金运作发展到一定阶段后，本基金可能会将测算基础转为代表相同风险度的周或月跟踪偏离度，具体变化将另行公告。

（2）卫星组合投资策略：“研究型”优选个股主动投资策略

本基金管理人借鉴外方股东加拿大蒙特利尔银行金融集团（BMO Financial Group）的投资管理经验及技能，结合国内市场的特征，对卫星组合进行“研究型”优选个股主动投资操作。主要策略包括：

策略一：利用数量化投资技术与基本面研究相结合的研究方法，对具有竞争优势、蕴涵投资价值的个股进行投资。

策略二：及时把握一级市场上新股申购与增发的盈利机会。

此外，卫星部分投资组合还配以一定的主动性投资辅助策略，包括：进行股票与相应可转债之间的套利操作，提高资金运用效率；选择股票资产外其他金融工具进行投资操作，等等。

“研究型”优选个股主动投资策略的运用完全基于本基金管理人投研团队构建的“研究型基金”股票库（Research Fund Equity Pool）。

【1】股票库的构成

投研团队构建的股票库由三部分组成，即：备选股票库、核心股票库与临时股票库，三者之间互不重复。

●备选股票库—显现研究宽度

主要基于卖方研究成果，由本基金管理人确定一定数量的重点研究对象。备选股票库每季度调整一次，期间允许临时调整。

●核心股票库—彰显研究深度

主要基于本基金管理人的深度研究结果，确定一定数量的重点投资对象，彰现富国投研团队实力。核心股票库每季度调整一次，通常情况下，期间不允许调整。

●临时股票库—捕捉投资机会

主要纳入新股与增发股票，获取一、二级市场价差。股票数量不定，按照市场状况自行动态调整。包括IPO至上市后5天内的新发与增发股票，在发行后自动进入，上市5天后自动剔除。如果已进入核心股票库和备选股票库，则不进入或者自动剔除出临时股票库。

【2】备选股票库与核心股票库的构建过程

股票库由本基金管理人基金部和研究策划部共同构建，并由股票库管理委员会统筹、协调、审批和最终确认。

●备选股票库筛选过程

行业研究员与基金经理综合运用“自上而下”与“自下而上”相结合的方法，在卖方研究基础上，对可选范围内上市公司进行重点研究，挑选备选股票库对象。具体过程如下：

★ 在上期备选股票库基础上，由行业研究员提出新增（包括从核心股票库调整至备选股票库）、剔除（剔除出整个股票库）名单，并同时提供近期（1个季度内）完成的研究简报、深度研究报告或者卖方近期（1个季度内）深度研究报告；

★ 由股票库管理委员会投票，投票人数不少于全部委员的2/3，通过人数超过投票人数2/3后进行正式调整。

●核心股票库筛选过程

行业研究员和基金经理综合运用“自上而下”与“自下而上”相结合的方法，对可选范围内上市公司进行深入研究，挑选核心股票库对象。具体过程如下：

★ 在上期核心股票库基础上，在季度末（季度结束前3天）由行业研究员提出新增、剔除（剔除出整个股票库）与调整（从核心股票库调整至备选股票库）名单，并同时提供近期（1个季度内）完成的深度研究报告、完整的财务预测模型等；

★ 由股票库管理委员会召集召开听证会，相关研究员介绍新增、剔除和调整核心股票库的理由，所有投资研究人员均可参与；

★ 由股票库管理委员会投票，投票人数不少于全部委员的2/3，通过人数超过投票人数2/3后进行正式调整。

由于行业研究员采用“自下而上”方式建立股票库，整个股票库数量如不加以控制将难以稳定。因此，需要由股票库管理委员会督促相关人员进行数量调整。

【3】股票库管理委员会的构成

委员会成员构成：投资总监、研究部经理、基金经理与部分相关行业研究员

【4】股票库管理委员会的职责

●召集听证会；

●审议备选与核心股票库调整，并通过投票方式形成最终股票库；

●以书面形式对行业研究员所覆盖股票库提供修改意见，包括：股票库中股票数量、研究报告修改意见与财务预测模型修改意见等。

图1 核心—卫星投资策略图例

3、债券投资策略

在目前中国债券市场处于制度与规则快速调整的阶段，本基金将采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在有效控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架；对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

【1】久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期，有效的控制整体资产风险；

【2】期限结构配置是在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利；

【3】市场转换是指管理人将针对债券子市场间不同运行规律和风险—收益特性构建和调整组合，提高投资收益；

【4】相对价值判断是在现金流特征相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的类属，减持相对高估、价格将下降的类属；

【5】信用风险评估是指管理人将充分利用现有行业与公司研究力量，根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估，以此作为品种选择的基本依据。

本基金投资策略示意图如下：

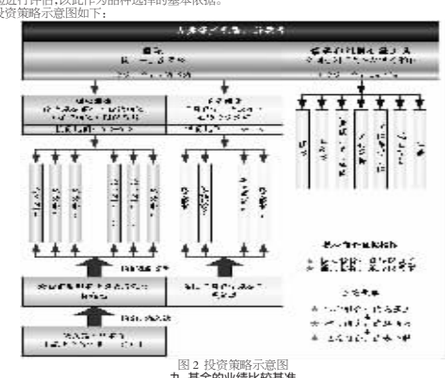


图2 投资策略示意图

九、基金的业绩比较基准

中信标普300指数×80%＋中信国债指数×15%＋同业存款利率×5%

十、基金的风险收益特征

本基金是一只主动投资的股票型基金，力争在稳健投资的基础上实现对基金业平均收益水平的超越，属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种。

十一、基金的投资组合报告

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,641,676,555.13	93.62
	其中：股票	2,641,676,555.13	93.62
2	固定收益投资	154,503,800.00	5.48
	其中：债券	154,503,800.00	5.48
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	15,894,933.06	0.56
6	其他资产	9,629,036.61	0.34
7	合计	2,821,704,324.80	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,645.50	0.00
B	采矿业	168,395,245.91	6.02
C	制造业	1,698,968,599.09	60.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	580.14	0.00
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	359,880,331.86	12.86
G	交通运输、仓储和邮政业	4,987.66	0.00
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	237,028,769.86	8.47
J	金融业	1,434.31	0.00
K	房地产业	177,390,598.76	6.34
L	租赁和商务服务业	2,538.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	824.04	0.00
S	综合	–	–
	合计	2,641,676,555.13	94.42

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002024	苏宁云商	44,350,458	282,512,417.46	10.10
2	000581	威孚高科	6,679,482	251,415,702.48	8.99
3	600570	恒生电子	20,398,129	237,026,258.98	8.47
4	000625	长安汽车	24,045,925	223,627,102.50	7.99
5	000887	中鼎股份	13,863,200	179,667,072.00	6.42
6	600208	新湖中宝	54,749,333	177,387,838.92	6.34
7	600060	海信电器	13,608,189	173,232,245.97	6.19
8	000895	双汇发展	1,830,462	147,901,329.60	5.29
9	600887	伊利股份	3,831,703	121,388,351.04	4.34
10	002215	诺普信	10,253,817	89,720,898.75	3.21

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	45,072,000.00	1.61
2	央行票据	–	–
3	金融债券	99,899,000.00	3.57
	其中：政策性金融债	99,899,000.00	3.57
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	9,532,800.00	0.34
8	其他	–	–
9	合计	154,503,800.00	5.52

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	130002	13附息国债02	400,000	40,056,000.00	1.43
2	120245	12国开45	400,000	39,980,000.00	1.43
3	100223	10国开23	300,000	29,931,000.00	1.07
4	120238	12国开38	200,000	19,992,000.00	0.71
5	130201	13国开01	100,000	9,996,000.00	0.36

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

9、投资组合报告附注

（1）申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

（2）申明本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,350,511.09
2	应收证券清算款	6,141,148.63
3	应收股利	–
4	应收利息	1,680,812.19
5	应收申购款	456,564.70
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	9,629,036.61

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中没有在流通受限情况。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

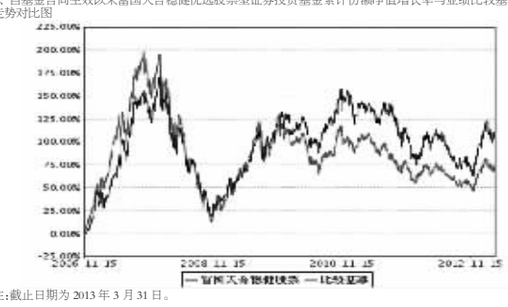
十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、富国天合稳健优选股票型证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2006.11.15-2006.12.31	17.14%	0.97%	27.82%	1.23%	-10.68%	-0.26%
2007.1.1-2007.12.31	115.92%	1.91%	117.98%	1.83%	-2.06%	0.08%
2008.1.1-2008.12.31	-46.75%	2.11%	-55.10%	2.40%	8.35%	-0.29%
2009.1.1-2009.12.31	71.05%	1.53%	72.36%	1.63%	-1.31%	-0.10%
2010.1.1-2010.12.31	7.24%	1.35%	-8.12%	1.25%	15.36%	0.10%
2011.1.1-2011.12.31	-24.71%	1.25%	-20.30%	1.04%	-4.41%	0.21%
2012.1.1-2012.12.31	6.01%	1.42%	6.65%	1.00%	-0.64%	0.42%
2013.1.1-2013.3.31	3.55%	1.63%	-0.19%	1.20%	3.74%	0.43%
2006.11.15-2013.3.31	104.20%	1.62%	68.08%	1.60%	36.12%	0.02%

2、自基金合同生效以来富国天合稳健优选股票型证券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：截止日期为2013年3月31日。

本基金于2006年11月15日成立，建仓期6个月，从2006年11月15日至2007年5月14日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关费用列示

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）基金合同生效后的基金信息披露费用；

（4）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金的证券交易费用；

（7）银行汇划费用；

（8）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

本基金合同终止，基金财产清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理费

本基金的管理费按该基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管费

本基金的托管费按基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×2.5‰÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（3）上述“1、与基金运作有关费用列示”中（3）－（7）项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，从基金资产中支付。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

（1）投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

（2）投资者选择交纳前端申购费用时，按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
100万元以下	1.5%
100万元（含）—500万元	1.2%
500万元（含）以上	1000元/笔

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

（3）投资者选择交纳后端申购费用时，按申购金额采用比例费率，费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间	后端申购费率
1年以内（含）	1.8%
1年—3年（含）	1.2%
3年—5年（含）	0.6%
5年以上	0

因红利自动再投资而产生的后端收费的基金份额，不再收取后端申购费用。

2、赎回费

本基金根据投资者认（申）购方式采用不同的赎回费率。

投资者选择交纳前端认（申）购费用时，适用的赎回费率为0.5%。

投资者选择交纳后端认（申）购费用时，适用变动的赎回费率。赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间	赎回费率
2年以内（含）	0.6%
2年—3年（含）	0.3%
3年以上	0

3、转换费

（1）前端转前端

基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。其中：转出基金赎回费是按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用；转入基金申购补差费是按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。对于前端转前端模式，转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的，补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额；转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的，补差费为零。基金转换的计算公式如下：

转出基金赎回费＝转出金额×转出基金赎回费率

转入金额＝转出金额－转出基金赎回费

净转入金额＝转入金额－（1＋申购补差费率）

申购补差费＝转入金额－净转入金额

转入份额＝净转入金额／转入基金当日之基金份额净值

注：转换份额的计算结果保留到小数点后2位。如转出基金为货币基金，且全部份额转出账户时，则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

（2）后端转后端

后端收费模式基金发生转换时，其转换费由转出基金的赎回费和申购补差费两部分构成，其中申购补差费率按照转入基金与转出基金的后端申购费率的差额计算。当转出基金后端申购费率高于转入基金后端申购费率时，基金转换申购费补差费率为转出基金与转入基金申购费率之差；当转出基金的后端申购费率低于转入基金的后端申购费率，申购补差费率为零。

1）对于由中国证券登记结算有限责任公司担任注册登记机构的基金，其后端收费模式下份额之间互相转换的计算公式如下：

转出金额＝转出份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金赎回费用＝转出金额×转出基金赎回费率

申购补差费用＝（转出金额－转出基金赎回费用）×补差费率

净转入金额＝转出金额－转出基金赎回费用－申购补差费用

转入份额＝净转入金额／转换申请当日转入基金的基金份额净值

2）对于由本公司担任注册登记机构的基金，后端收费模式下基金份额之间互相转换的计算公式如下：

转出金额＝转出份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金赎回费用＝转出金额×转出基金赎回费率

申购补差费＝（转出金额－转出基金赎回费用）×补差费率／（1＋补差费率）

净转入金额＝转出金额－转出基金赎回费用－申购补差费用

转入份额＝净转入金额／转换申请当日转入基金的基金份额净值

注：转换份额的计算结果保留到小数点后2位。如转出基金为货币基金，且全部份额转出账户时，则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记人处注册登记的、同一收费模式的开放式基金。

（三）基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、“重要提示”部分对更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期进行了更新。

2、“三、基金管理人”部分对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。

3、“四、基金托管人”部分对基金托管人发展概况及基金托管业务经营情况等内容进行了更新。

4、“五、相关服务机构”部分对代销机构部分信息进行了更新。

5、“八、基金份额的申购与赎回”部分对申购和赎回的场所进行了更新，完善了基金转换业务名单和规则。

6、“九、基金的投资”部分对投资组合报告内容更新至2013年3月31日。

7、“十、基金的业绩”部分对基金业绩更新至2013年3月31日，并更新了历史走势对比图。

8、“十七、风险揭示”部分在声明中对本基金的代销机构进行了更新。

9、“二十二、其它应披露事项”部分对更新期内应披露的本基金相关事项进行了更新。

富国基金管理有限公司
二〇一三年六月二十一日

（上接B41版）

联系人：张青
电话：（0755）82088888
传真：（0755）82080714
客户服务统一咨询电话：95501
公司网站：www.sdb.com.cn
（53）华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张鹏
联系电话：0591-87383623
传真：0591-87383610
客服电话：96326（福建省外请先按0591）
公司网址：www.hfzq.com.cn
（54）新时代证券有限责任公司
注册地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦1501室
办公地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦1501室
法定代表人：李文义
联系人：秦宇
电话：010-68083578
客服电话：010-68083601
公司网址：www.xsdzq.cn
（55）江海证券有限公司
注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张宇宏
传真：0451-82287211
联系电话：0451-82336863
客户服务热线：400-666-2288
公司网站：www.jhzq.com.cn
（56）信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
客服电话：400-800-8899
公司网站：www.cindasc.com
（57）华龙证券有限责任公司
住所：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李晓安
电话：（0931）4890100
传真：（0931）4890118
联系人：李昕田
客服电话：（0931）4890100、4890619、4890618
公司网站：www.hlzqgs.com
（58）大通证券股份有限公司
注册地址：大连市中山区人民路24号
办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人：张智河
电话：0411-39673202
传真：0411-39673219
联系人：谢立军
客服电话：4008-169-169
公司网站：www.daton.com.cn
（59）中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼
法定代表人：肖钢
传真：（010）66594946
客服电话：95566
公司网站：www.boc.cn
（60）宁波银行股份有限公司
注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号
办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人：陆华裕
电话：0574-87050024
联系人：胡技勤
客服电话：96528（上海、北京地区962528）
公司网站：www.nbcb.com.cn
（61）上海银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路168号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：范一飞
联系电话：（021）68475888
传真：（021）68476111
联系人：龚厚红
客服电话：（021）962888
公司网站：www.bankofshanghai.com
（62）渤海证券股份有限公司
注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：杜庆平
电话：022-28451861
传真：022-28451892
联系人：王兆权
客户服务热线：400-651-5988
公司网站：www.bhzq.com
（63）金元证券股份有限公司
注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人：陆涛
联系人：马骁清
电话：0755-83025022
传真：0755-83025625
客户服务电话：400-8888-228
公司网站：www.jyzq.cn
（64）天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：林爽
联系电话：010-66045608
传真：010-66045521
客服电话：010-66045678
公司网站：www.txsec.com
（65）中原证券股份有限公司
注册地址：郑州郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州郑东新区商务外环路10号
法定代表人：菅明军
联系电话：0371-65585287
传真：0371-65585665
联系人：陈利民
客户咨询电话：967218（郑州市外拨打加拨区号）、400-813-9666
公司网站：www.ccnew.com
（66）财富里昂证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人：罗浩
电话：021-38784818
传真：021-68775878
联系人：倪丹
客户服务电话：68777877
公司网站：www.cf-cba.com
（67）深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、单元
法定代表人：薛峰
联系人：汤素娅
电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
客户服务电话：4006-788-887
公司网址：众禄基金网 www.zlfund.cn基金买卖网 www.jjmmw.com
（68）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
联系人：沈雪斌
联系电话：021-58788678-8201，13585790204
传真：021-58787698
客服电话：400-089-1289
公司网站：www.erichfund.com
（69）北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：李二钢
电话：（010）62020088
传真：（010）62020088
客户服务电话：4008886661
公司网站：www.myfund.com
（70）华夏银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街22号
办公地址：北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人：吴建
联系人：郑鹏
电话：010-85238667
传真：010-85238680
客户服务电话：95577
公司网站：www.hxb.com.cn
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层

办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人：陈耀先

电话：（010）58598839

传真：（010）58598907

联系人：刘玉生

（三）出具法律意见书的律师事务所（基金募集时）

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

联系电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：廖海

经办律师：廖海、吕红

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所有限责任公司

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼

法定代表人：葛明

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：徐艳

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

四、基金的名称

富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

混合型

六、基金的投资目标

本基金主要投资于具有良好成长性且合理定价的股票，在利用金融工程技术控制组合风险的前提下，谋求基金资产的长期最大化增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其中债券部分包括国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）以及中国证监会允许基金投资的其他债券。基金股票部分主要投资于具有良好成长性且合理定价的上市公司股票。该类股票应具体满足以下特征：

1、预期